



撰写人：蔡跃辉
 从业资格证号：F0251444
 投资咨询从业证书号：Z0013101

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	I 主力合约收盘价 (元/吨)	821.00	+2.00↑	I 主力合约持仓量(手)	831,727	-1768↓
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	70.5	0.00	I 合约前20名净持仓(手)	22704	-1309↓
	I 大商所仓单 (手)	1,700.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15: 00报价(美元/吨)	108.9	+0.49↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	926	+3↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	913	+3↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	791	-2↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	92	+1↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	110.55	-1.05↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.40	+0.01↑
	进口成本预估值(元/吨)	930	-10↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,943.90	+266.10↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,428.00	+60.00↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,742.00	-50.98↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,544.52	-29.85↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,617.00	+573.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	17.00	0.00
	全国126座矿山开工率(旬, %)	65.65	+1.23↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	119.38	-0.80↓
	BDI指数	1,068.00	-23.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.77	+0.06↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.19	-0.12↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.09	0.00	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.98	+0.38↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,012	-251↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	24.51	+0.01↑	标的历史40日波动率(日, %)	32.21	-0.03↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	30.09	-2.21↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	30.85	-0.34↓
行业消息	1、6月26日-7月2日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量 2943.9万吨，环比增加266.1万吨。澳洲发运量2059.5万吨，环比增加241.6万吨，其中澳洲发往中国的量1732.2万吨，环比增加184.6万吨。巴西发运量884.5万吨，环比增加24.5万吨。 2、7月1日-7月31日，唐山钢企执行环保限产。据调研，区域内钢厂均已经执行攻坚措施，目前区域内钢厂烧结A级限产30%，B级及以下钢铁烧结限产50%，18时至次日8时运输不可使用油车。由于区域内多数钢厂烧结矿库存富裕，限产下预计烧结矿库存能坚持20天左右。					 更多资讯请关注！
观点总结	周二I2309合约反弹受阻，进口铁矿石现货报价小幅上调。本期铁矿石到港量及发运量均出现增加，将提升现货供应。贸易商报价积极性一般，报价多随行就市，钢厂询盘少，市场交投氛围一般。目前钢厂利润有所改善，钢厂生产积极性尚可，铁水维持高位波动，短期铁矿需求仍存韧性。技术上，I2309合约1小时MACD 指标显示DIFF与 DEA运行于0轴附近。操作上建议，短线于830-800区间高抛低吸，止损10元/吨。					 更多观点请咨询！
重点关注						